

基金管理人:泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
2014年3月27日

重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及高级管理人员均持有本公司股票,不存在任何影响基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金投资者、基金持有人利益的重大事项,并对本报告的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及高级管理人员均持有本公司股票,不存在任何影响基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金投资者、基金持有人利益的重大事项,并对本报告的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及高级管理人员均持有本公司股票,不存在任何影响基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金投资者、基金持有人利益的重大事项,并对本报告的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

泰达宏利中证500指数分级证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31日

1.1 基金基本情况	
基金简称	泰达宏利中证500指数分级
基金代码	162216
申购赎回代码	162216
基金合同生效日	2013年12月17日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	17,153,723,809份
基金上市交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-12-20
下属分级基金的基金简称	泰达宏利中证500指数分级证券投资基金
下属分级基金的基金代码	150053
报告期末基金份额总额	2,274,876,000份

2.2 基金业绩指标	
投资目标	本基金采用指数化投资策略,紧密跟踪中证500指数,力争使本基金的跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.5%以内,超额收益不超过1%以内。
投资策略	本基金采用被动式投资策略,紧密跟踪中证500指数的表现,力求跟踪中证500指数的表现,力争使本基金的跟踪误差控制在年化跟踪误差率不超过0.5%以内,超额收益不超过1%以内。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:95%×中证500指数收益率+5%×同期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险、高收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

3.1 主要会计数据和财务指标				
3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2013年12月31日/2012年12月31日	2013年12月31日/2012年12月31日
本期利润总额	7,113,653.74	3,133,290.16	-	-1,336,893.32
本期净利润	6,450,715.14	9,020,564.64	-	-5,569,870.74
加权平均基金份额本期利润	0.2214	0.0888	-	-0.0409
本期基金份额净值增长率	14.55%	-1.40%	-	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.1035	-0.0341	-	-0.0196
期末基金份额净值	18.40113101	58.59448701	-	241.85748801
期末基金份额总额	1,072,810,960	1,090,810,960	-	20,895,710

3.2 基金业绩比较基准				
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较				
阶段	基金份额净值增长率①-③	业绩比较基准收益率②-③	①-②	②-③
最近三个月	-1.52%	1.32%	-1.01%	1.33%
过去六个月	16.10%	1.32%	17.49%	1.33%
过去一年	14.55%	1.37%	16.29%	1.37%
自基金合同生效以来	10.69%	1.37%	0.83%	1.43%



本基金于2011年12月17日成立,建仓期为6个月,本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同约定的投资比例。
3.2.3 自基金合同生效以来,本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



本基金合同生效日为2011年12月17日,2011年度净值增长率的计算期间为2011年12月17日至2011年12月31日。
3.3 过去三年基金净值增长率、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图

4.1 基金管理人及基金托管人	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.2 基金管理人及基金托管人	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.3 基金管理人及基金托管人	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.4 基金管理人及基金托管人	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

4.5 基金管理人及基金托管人	
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
5.3 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
5.4 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

6 财务会计报告
7 1.1 资产状况
7.1 资产状况
7.2 资产状况

资产	
货币资金	1,305,609.19
结算备付金	26,699.51
存出保证金	7,126.80
交易性金融资产	17,465,136.93
其中:股票投资	17,465,136.93
债券投资	-
其他金融资产	-
应收款项	-
预付款项	-
应收证券清算款	-
买入返售金融资产	-
其他金融资产	-
应收利息	255.55
应收股利	-
其他应收款	1,383.40
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	18,806,202.38

负债和所有者权益	
负债	18,806,202.38
所有者权益	60,252,892.30
未分配利润	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

所有者权益	
未分配利润	60,252,892.30
其他所有者权益	-
所有者权益合计	60,252,892.30

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	300,287.81	1,054,478.36
其中:支付销售机构的客户维护费	90,531.29	164,800.55

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	60,057.60	210,895.71

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

注:买入金额(或 买入股票成本)、卖出金额(或 卖出股票收入)均按买卖成交金额(成交价款)或成交数量(成交量)乘以不含佣金成交金额(或 买入股票成本)、卖出金额(或 卖出股票收入)均按买卖成交金额(成交价款)或成交数量(成交量)乘以不含佣金成交金额(或 买入股票成本)计算。
8.4.3 买入股票的成本总额减去卖出股票的收入总额

单位:人民币元	
买入股票成本	59,261,493.08
卖出股票收入	101,111,043.58

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	300,287.81	1,054,478.36

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	60,057.60	210,895.71

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元		
项目	2013年1月1日至2013年12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的利息	1,305,609.19	12,557.22

单位:人民币元	
---------	--